АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ
Б1.В.ДВ.05.02 Управление портфелем ценных

Наименование образовательной программы: Финансовая экономика
Код и наименование направления подготовки: 38.04.08 Финансы и кредит
Формы обучения: очная, заочная
Планируемые результаты освоения дисциплины

1.1 Дисциплина Б1.В.ДВ.05.02 Управление портфелем ценных бумаг обеспечивает овладение следующими компетенциями с учетом этапа:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код компонента компетенции	Наименование компонента компетенции
ПКс 2	Способность осуществлять разработку инструментов проведения исследований в области финансов и кредита, анализ их результатов, подготовку данных для составления финансовых обзоров, отчетов.	ПКс 2.2	Способен осуществлять анализ результатов финансовых исследований и формировать данных для составления финансовых обзоров, отчетов

В результате освоения компетенции у студентов должны быть сформированы:

Профессиональные действия	Код компонента компетенции	Результаты обучения
D Руководство самостоятельным специальным подразделением внутреннего контроля (частично) Специалист по внутреннему контролю (внутренний контролер) D/03.7Рассмотрение и утверждение плановых и отчетных документов о работе самостоятельного специального подразделения внутреннего контроля и их представление вышестоящему руководству экономического субъекта Руководство разработкой предложений по внесению изменений в действующую нормативную базу и в методики проведения внутреннего контроля D/07.7	ПКс 2.2	На уровне знаний: основы трудового, гражданского, административного, уголовного законодательства Российской Федерации, устав, политика, программы и другие основополагающие документы экономического субъекта; практики применения для разработки риск-ориентированных планов и отчетов нормативной базы и методик экономического субъекта и внутренних регламентов самостоятельного специального подразделения внутреннего контроля
		На уровне умений: анализировать риски бизнес-процессов

		На уровне навыков: способность принимать решения в сфере совершения операций с ценными бумагами, с учётом имеющихся финансово-экономических рисков

Объем дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы (108 ак. ч./81 астр. ч.).:

-для очной формы обучени:40 акад.часов/ 30 астр.час. на контактную работу (16 акад. часов/ 12 астр.час. лекционных, 24 акад. часов/18 астр.час. практических занятий) и 68 акад.час/ 51 астр.час. на самостоятельную работу обучающихся.

- для заочной формы обучени:10 акад.часов/ 7,5 астр.час. на контактную работу (4 акад. часов/ 3 астр.час. лекционных, 6 акад. часов/4,5 астр.час. практических занятий) и 98 акад.час/ 73,5 астр.час. на самостоятельную работу обучающихся.

Содержание и структура дисциплины (модуля)
Очная форма обучения

№ п/п	Наименование тем (разделов)	Объем дисциплины (час.)						Форма текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий				СР	
			Л/ ДОТ	ЛР/ ДОТ	ПЗ/ ДОТ	КСР		
1	Сущность портфельной теории, ее составляющих. Модели построения оптимального инвестиционного портфеля	27	4	-	6	-	15	О
2	Портфель ценных бумаг: сущность, состав, принципы формирования, классификация	27	4	-	6	-	15	О
3	Модели оценки доходности активов. Определение эффективной границы и оптимальных портфелей	27	4	-	6	-	15	О,Э,Р
4	Управление портфелем ценных бумаг: стратегии и инструменты	27	4	-	6	-	23	О,ИЗ, К,Т
	Промежуточная аттестация	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**		**зачет**

	Всего	**108**	**16**	**-**	**24**	**-**	**68**	

Л – занятия лекционного типа (лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся);
ЛР – лабораторные работы (вид занятий семинарского типа);
ПЗ – практические занятия (виды занятий семинарского типа за исключением лабораторных работ);
КСР – индивидуальная работа обучающихся с педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях (в том числе индивидуальные консультации);
ДОТ – занятия, проводимые с применением дистанционных образовательных технологий, в том числе с применением виртуальных аналогов профессиональной деятельности;
СРО – самостоятельная работа, осуществляемая без участия педагогических работников организации и (или) лиц, привлекаемых организацией к реализации образовательных программ на иных условиях.

Примечание: формы текущего контроля успеваемости: опрос (О), тестирование (Т), конференция (К), выполнение индивидуальных заданий (ИЗ), Э (эссе), Р (реферат).
** - занятие проводится в интерактивной форме*

Заочная форма обучения

1	Сущность портфельной теории, ее составляющих. Модели построения оптимального инвестиционного портфеля	27	1	-	2	-	24	О
2	Портфель ценных бумаг: сущность, состав, принципы формирования, классификация	26	1	-	1	-	24	О
3	Модели оценки доходности активов. Определение эффективной границы и оптимальных портфелей	25	1	-	1	-	23	О, Р
4	Управление портфелем ценных бумаг: стратегии и инструменты	26	1	-	2	-	23	ИЗ, К
	Промежуточная аттестация	**-**						**зачет**
	Всего	**108**	**4**	**–**	**6**		**94**	

Л – занятия лекционного типа (лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся);
ЛР – лабораторные работы (вид занятий семинарского типа);
ПЗ – практические занятия (виды занятий семинарского типа за исключением лабораторных работ);
КСР – индивидуальная работа обучающихся с педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях (в том числе индивидуальные консультации);
ДОТ – занятия, проводимые с применением дистанционных образовательных технологий, в том числе с применением виртуальных аналогов профессиональной деятельности;
СРО – самостоятельная работа, осуществляемая без участия педагогических работников организации и (или) лиц, привлекаемых организацией к реализации образовательных программ на иных условиях.

Примечание: формы текущего контроля успеваемости: опрос (О), тестирование (Т), конференция (К), выполнение индивидуальных заданий (ИЗ), Э (эссе), Р (реферат).
** - занятие проводится в интерактивной форме*

Форма промежуточной аттестации: зачёт.

Основная литература:

1. Рынок ценных бумаг : учебник для вузов / Н. И. Берзон [и др.] ; под общей редакцией Н. И. Берзона. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 514 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11196-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/. 2. Чалдаева, Л. А. Рынок ценных бумаг : учебник для вузов / Л. А. Чалдаева, А. А. Килячков. — 7-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 381 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08142-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/488673.